Información de mercado
República de Colombia
Ministerio de Hacienda y Crédito Público

miércoles, 27 de diciembre de 2023

Noticias del día

Según la Agencia Federal de Financiamiento de la Vivienda, los precios de las viviendas en Estados Unidos aumentaron un 6,3% anual en octubre, lo que indica una recuperación continua del mercado inmobiliario; esto representa un ligero aumento en comparación con el mes anterior, donde el crecimiento fue del 6,2%. El crecimiento anual de los precios comenzó a acelerarse en junio después de disminuir constantemente desde febrero de 2022 y los precios aumentaron moderadamente un 0,3% en términos intermensuales después de subir un 0,7% el mes anterior. Finalmente, el bono de referencia a diez años cerró en 3,80% y una disminución de 10 puntos básicos, mientras que el bono a 30 años cerró en 3,96% y una disminución de 9 puntos básicos.

Por medio de un encuentro con los medios del BBC en Londres, el ministro de Finanzas británico, Jeremy Hunt, aseguró que presentará el presupuesto de primavera con fecha final para el seis de marzo, que incluirá los planes de gasto y rentas tributarias, al igual que los pronósticos de crecimiento, crédito y las emisiones de deuda soberana para el año financiero 2024-2025. Mientras tanto, se espera la fecha para iniciar las elecciones generales en Reino Unido a más tardar para el 28 de enero del 2025; sin embargo, el actual primer ministro británico, Rishi Sunak, aseguró que se hará lo posible para poder llevarlas a cabo a lo largo del próximo año. Según la encuesta realizada por la consultora de investigación de mercados, Ipsos, se muestra un apoyo del 24% al partido Conservador, mientras que el partido Laborista tiene un apoyo del 41%, el partido Liberal Demócrata con un 13% y los verdes con 9%.

El Gobierno nacional aprobó el mayor cupo para el mecanismo de obras por impuestos, liderado por el ministro de Hacienda y Crédito Público y el director del Departamento Nacional de Planeación. Esta aprobación permite que las empresas paguen hasta el 50% de sus impuestos en proyectos de inversión en municipios PDET (Programa de Desarrollo con Enfoque Territorial) y Zomac (Zonas más afectadas por el Conflicto). Para el 2024, se aprobó un billón de pesos como el mayor cupo para el mecanismo de Obras por Impuestos desde su creación en 2018. El CONFIS dejó abierta la posibilidad de ampliar este cupo con el objetivo de impulsar proyectos que aceleren la implementación del Plan Nacional de Desarrollo, priorizando áreas como transición energética, vías terciarias e integración digital. Por último, el dólar spot tuvo una variación de -1,0% con respecto a la jornada anterior, cerrando en COP $3.820,00.

El Departamento de Energía de los Estados Unidos, afirmó que se ha finalizado la compra de tres millones de barriles de crudo para volver a reabastecer la reserva estratégica de petróleo (SPR), siendo esta la compra más grande de crudo del año. Es importante tener en cuenta, que la administración de Joe Biden no solo ha venido haciendo adquisiciones de crudo, sino también ha realizado ventas de más de 180 millones de barriles a lo largo del año, para poder controlar los precios del petróleo después de la invasión de Rusia a Ucrania. Como resultado, el precio del crudo Brent cayó 2,0% y alcanzó los 79,41 dólares por barril, mientras que el crudo estadounidense West Texas Intermediate (WTI) cayó un 1,9% y llegó a los 74,11 dólares por barril. Por último, el precio del oro tuvo una variación del 0,5% y cerró en 2.077,49 dólares por onza.

Tes Globales

Fecha de vencimiento	Cupón	Vigente*	Vida Media	Duración	Precio	Rendimiento	Spread sobre TES
28-jun-27	9,85%	COP 1.924	3,50	1,65	96,23	11,16%	8 Pb

* El monto emitido en COP puede ser diferente del monto vigente por efecto de canjes y/o amortizaciones.

Bonos Globales denominados en Dólares

Fecha de vencimiento	Cupón	Vigente*	Vida Media	Duración	Precio	Rendimiento	G - Spread**	Var. Ayer Spreads	Var. Año Corrido	Var. Anual Spreads
21-may-24	8,125%	USD 659	0,40	0,40	100,82	5,98%	61 Pb	2 Pb	-84 Pb	-112 Pb
28-ene-26	4,500%	USD 1.500	2,09	1,14	97,98	5,54%	132 Pb	7 Pb	-112 Pb	-124 Pb
25-abr-27	3,875%	USD 1.897	3,33	1,88	95,20	5,47%	152 Pb	3 Pb	-141 Pb	-153 Pb
15-mar-29	4,500%	USD 2.000	5,22	2,69	93,32	6,01%	221 Pb	5 Pb	-102 Pb	-108 Pb
30-ene-30	3,000%	USD 1.543	6,09	2,97	84,05	6,18%	238 Pb	4 Pb	-97 Pb	-102 Pb
15-abr-31	3,125%	USD 2.540	7,30	3,65	81,29	6,37%	256 Pb	3 Pb	-85 Pb	-84 Pb
22-abr-32	3,250%	USD 2.000	8,32	4,07	79,51	6,47%	267 Pb	5 Pb	-82 Pb	-83 Pb
20-abr-33	8,000%	USD 1.624	9,31	4,46	109,01	6,68%	286 Pb	4 Pb	-127 Pb	-127 Pb
2-feb-34	7,500%	USD 2.200	10,10	4,55	105,28	6,77%	296 Pb	3 Pb	-111 Pb	N/A
14-nov-35	8,000%	USD 1.250	11,88	5,39	109,15	6,86%	300 Pb	5 Pb	-39 Pb	N/A
18-sep-37	7,375%	USD 1.818	13,73	5,93	103,48	6,98%	306 Pb	4 Pb	-105 Pb	-105 Pb
18-ene-41	6,125%	USD 2.500	17,06	6,89	90,55	7,09%	307 Pb	4 Pb	-119 Pb	-121 Pb
22-feb-42	4,125%	USD 1.000	18,15	7,27	71,19	6,94%	289 Pb	3 Pb	-96 Pb	-101 Pb
26-feb-44	5,625%	USD 2.500	20,16	7,92	83,67	7,17%	307 Pb	2 Pb	-116 Pb	-118 Pb
15-jun-45	5,000%	USD 4.500	21,47	8,40	77,07	7,10%	301 Pb	4 Pb	-94 Pb	-94 Pb
15-may-49	5,200%	USD 2.800	25,38	9,34	77,86	7,09%	307 Pb	3 Pb	-107 Pb	-110 Pb
15-may-51	4,125%	USD 1.500	27,38	9,78	66,27	6,88%	288 Pb	4 Pb	-74 Pb	-78 Pb
14-nov-53	8,750%	USD 1.250	29,88	10,43	114,97	7,49%	286 Pb	-62 Pb	-115 Pb	N/A
15-feb-61	3,875%	USD 1.300	37,13	10,96	62,10	6,63%	268 Pb	4 Pb	-72 Pb	-74 Pb

Bono Global denominado en Euros

Fecha de vencimiento	Cupón	Vigente*	Vida Media	Duración	Precio	Rendimiento	G - Spread**	Var. Ayer Spreads	Var. Año Corrido	Var. Anual Spreads
22-mar-26	3,875%	EUR 1.350	2,24	1,31	98,72	4,48%	220 Pb	17 Pb	362 Pb	#¡VALOR!

* En millones

** Spread bonos en dólares sobre curva benchmark interpolada.
Vida Media: Dias faltantes al vencimiento/360
Duracion de Macaulay

Tasas de Interés y Rendimientos

Tasas de interés y rendimientos			
Indicador	27/12/2023	Variación diaria*	Variación Anual
FED Funds Rate	5,50	0 Pb	100 Pb
LIBOR 3 meses	5,61	0 Pb	89 Pb
LIBOR 6 meses	5,62	0 Pb	-510 Pb
SOFR *(overnight)*	5,35	3 Pb	105 Pb
Tesoros 2 años	4,25	-11 Pb	-14 Pb
Tesoros 5 años	3,80	-9 Pb	-15 Pb
Tesoros 10 años	3,80	-10 Pb	-5 Pb
Tesoros 20 años	4,11	-10 Pb	0 Pb
Tesoros 30 años	3,96	-9 Pb	2 Pb

** La variación diaria es con respecto al día anterior.*

Commodities, monedas e indicadores de volatilidad

Commodities			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
Oro	2.077,49	0,5%	14,5%
Petroleo WTI	74,11	-1,9%	-6,8%
Petroleo BRENT	79,41	-2,0%	-5,8%
Monedas Spot			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
COP	3.820,00	-1,0%	-19,8%
BRL	4,83	0,2%	-8,7%
MXN	16,92	-0,4%	-13,2%
JPY	141,83	-0,4%	6,2%
EUR	1,11	0,6%	4,4%
Indicadores de volatilidad			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
VIX	12,43	-4,3%	-42,6%
MOVE	114,53	-1,3%	-8,3%

Renta Variable

Mercado Accionario			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
Dow Jones	37.657	0,3%	13,3%
S&P	4.782	0,1%	24,9%
FTSE	7.725	0,4%	3,4%
Nikkei	33.681	1,1%	27,3%
MEX	57.554	-0,3%	14,1%
Bovespa	134.194	0,5%	23,6%
COLCAP	1.188	0,4%	-5,7%

Indicadores de Riesgo

EMBI+			
Indicador	27/12/2023	Variación diaria*	Variación Anual
EMBI G	320	1 Pb	-57 Pb
EMBI G Colombia	278	0 Pb	-94 Pb
EMBI+	346	2 Pb	-27 Pb
EMBI+ Colombia	271	1 Pb	-88 Pb
EMBI+ Perú	102	1 Pb	-42 Pb
EMBI+ Brasil	195	2 Pb	-68 Pb
EMBI+ México	168	3 Pb	-34 Pb

** La variación diaria es con respecto al día anterior.*

CDS 5 años			
Indicador	Hoy	Variación diaria	Variación Anual
CDS Colombia	159	0 Pb	-120 Pb
CDS Perú	71	0 Pb	-51 Pb
CDS Brasil	133	-1 Pb	-122 Pb
CDS México	89	-1 Pb	-42 Pb
CDS Chile	51	0 Pb	-58 Pb

CONDICIONES DE USO

La Dirección General de Crédito Público y del Tesoro Nacional, por intermedio de la Subdirección de Financiamiento Externo de la Nación, distribuye informes públicos y periódicos donde se incluyen datos relacionados con el mercado secundario de los títulos de deuda pública externa de la República de Colombia, tales como precios, spreads y rendimientos. Estos informes son remitidos previa solicitud del interesado y dejarán de enviarse cuando éste lo solicite. Dichos documentos contienen información general y por lo tanto, no puede considerarse que mediante uno o varios de ellos se realice una promoción comercial, invitación, asesoría, oferta, garantía u obligación de la República de Colombia o del Ministerio de Hacienda y Crédito Público, para vender, comprar, mantener títulos de deuda pública externa, o celebrar operaciones con derivados, ofertas, promesas o cualquier tipo de contrato u operación financiera relacionada con los mismos. En consecuencia, la Nación-Ministerio de Hacienda y Crédito Público no asume ningún tipo de responsabilidad por las consecuencias derivadas de las acciones u omisiones que se hayan fundamentado en estos informes. Los títulos de deuda externa sobre los cuáles versan estos informes fueron emitidos y colocados en los mercados internacionales de capitales, por lo cual es posible que a su circulación y pago se apliquen normas correspondientes a jurisdicciones extranjeras; nada en este informe puede entenderse como una modificación a los contratos, anexos y demás documentos suscritos en ejecución o desarrollo de operaciones de crédito público, asimiladas o conexas, o como un concepto sobre la posibilidad de realizar transacciones relacionadas con estos títulos en Colombia. Las citas, transcripciones o cualquier tipo de referencia que se haga a todo o parte de estos informes, deberá señalar expresamente la aplicación de estos términos y condiciones.